KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) 2022/1858

av den 10 juni 2022

om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 vad gäller tekniska tillsynsstandarder som specificerar förfarandena för avstämning av uppgifter mellan transaktionsregister och de förfaranden som ska tillämpas av transaktionsregistret för att kontrollera att den rapporterande motparten eller den inlämnande enheten uppfyller rapporteringskraven och för att kontrollera att de rapporterade uppgifterna är fullständiga och korrekta

(Text av betydelse för EES)

EUROPEISKA KOMMISSIONEN HAR ANTAGIT DENNA FÖRORDNING

med beaktande av fördraget om Europeiska unionens funktionssätt,

med beaktande av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 av den 4 juli 2012 om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister ([1]), särskilt artikel 78.10, och

av följande skäl:

(1) För att säkerställa att de uppgifter om derivat som rapporteras till transaktionsregister har hög kvalitet bör transaktionsregister kontrollera de rapportinlämnande enheternas identitet, den logiska tillförlitligheten hos den följd i vilken uppgifterna om derivat rapporteras och dessa uppgifters fullständighet och korrekthet.

(2) Av samma skäl bör transaktionsregistren stämma av uppgifterna i varje derivatrapport som mottas där båda motparterna är rapporteringsskyldiga. En standardiserad process bör införas för att transaktionsregister ska kunna genomföra avstämningar på ett konsekvent sätt och för att minska risken för att uppgifter om derivat inte stäms av. Emellertid är kanske vissa uppgifter om derivat inte identiska till följd av särdragen hos de tekniska system som de rapportinlämnande enheterna använder. Vissa toleranser bör således godtas så att smärre skillnader i inrapporterade uppgifter om derivat inte hindrar myndigheterna från att analysera uppgifterna med en tillräcklig konfidensgrad.

(3) Dessutom och utan hinder av andra skyldigheter med avseende på uppgifterna om derivat som samlas in och registreras vid avstämningen, bör transaktionsregistren säkerställa konfidentialiteten hos de uppgifter som utbyts mellan dem och görs tillgängliga för de rapporterande motparterna, de enheter som ansvarar för rapporteringen och de rapportinlämnande enheterna.

(4) Om en företagsomstruktureringshändelse leder till att en motparts identifieringskod för juridiska personer (LEI-kod) ändras, måste uppgifterna om de enheter som identifieras i en derivatrapport uppdateras. För att säkerställa denna informations integritet, vilket är av avgörande betydelse för övervakningen av systemrisker för den finansiella stabiliteten, är det nödvändigt att transaktionsregistren genomför uppdateringen centralt. Därför bör ett förfarande inrättas för att säkerställa att transaktionsregistren kan uppdatera enhetens identifieringskod på ett centraliserat sätt, vilket säkerställer en effektiv, robust och snabb process.

(5) De rapportinlämnande enheterna bör ges tillräckligt med tid att anpassa sig till rapportkraven, i synnerhet för att förhindra en ansamling av icke-avstämda transaktioner omedelbart efter det att rapportkraven börjar gälla. Följaktligen bör enbart en begränsad mängd fält stämmas av i en första fas.

([1]) EUT L 201, 27.7.2012, s. 1.

(6) De rapportinlämnande enheterna och, i tillämpliga fall, de enheter som ansvarar för rapportering bör kunna övervaka sin efterlevnad av rapportkraven enligt förordning (EU) nr 648/2012. De bör således få tillgång till viss information på daglig basis om de berörda rapporterna, inbegripet resultatet av kontrollen av dessa rapporter, även när en varning har skapats, och framstegen i avstämningen av rapporterade uppgifter. Det är följaktligen nödvändigt att ange vilken information som transaktionsregister bör göra tillgänglig för dessa enheter vid slutet av varje arbetsdag.

(7) Denna förordning grundar sig på det förslag till teknisk tillsynsstandard som Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten (Esma) har överlämnat till kommissionen.

(8) Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten har samrått med medlemmarna i Europeiska centralbanksystemet och har anordnat öppna offentliga samråd om det förslag till tekniska standarder för tillsyn som denna förordning bygger på, analyserat de potentiella kostnaderna och fördelarna därav och begärt råd från den intressentgrupp för värdepapper och marknader som inrättats i enlighet med artikel 37 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1095/2010 ([2]).

(9) För att göra det möjligt för motparter och transaktionsregister att vidta alla nödvändiga åtgärder för att anpassa sig till de nya kraven bör tillämpningsdatumet för denna förordning skjutas upp med 18 månader.

HÄRIGENOM FÖRESKRIVS FÖLJANDE.

Artikel 1

Transaktionsregisters kontroll av derivat

1. Ett transaktionsregister ska kontrollera följande i en mottagen derivatrapport:

a) identiteten på den enhet som lämnar in rapporten enligt fält 2 i tabell 1 och fält 2 i tabell 3 i bilagan till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2022/1860 ([3]).

b) Att xml-mallen som används för att rapportera ett derivat överensstämmer med ISO 20022-metoden i enlighet med artikel 1 i genomförandeförordning (EU) 2022/1860.

c) Att den rapportinlämnande enheten, om denna är en annan än den enhet som ansvarar för rapporteringen enligt fält 3 i tabell 1 och fält 3 i tabell 3 i bilagan till genomförandeförordning (EU) 2022/1860, är vederbörligen auktoriserad att inlämna rapport på uppdrag av motpart 1 eller den enhet som ansvarar för rapporteringen, om denna är en annan än motpart 1, enligt fält 4 i tabell 1 och fält 4 i tabell 3 i bilagan till genomförandeförordning (EU) 2022/1860.

d) Att samma derivat inte har lämnats in tidigare.

e) Att en derivatrapport med åtgärdstypen ”Ändring”, ”Marginaluppdatering”, ”Värdering”, ”Korrigering”, ”Fel” eller ”Avsluta” avser ett tidigare inlämnat derivat.

f) Att en derivatrapport med åtgärdstypen ”Ändring” inte avser ett derivat som har rapporterats som annullerat med åtgärdstypen ”Fel” och som inte senare har rapporterats med åtgärdstypen ”Förnya”.

g) Att en derivatrapport inte innefattar åtgärdstypen ”Ny” med avseende på ett derivat som tidigare har rapporterats.

([2]) Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1095/2010 av den 24 november 2010 om inrättande av en europeisk tillsynsmyndighet (Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten), om ändring av beslut nr 716/2009/EG och om upphävande av kommissionens beslut 2009/77/EG (EUT L 331, 15.12.2010, s. 84).

([3]) Kommissionens genomförandeförordning (EU) 2022/1860 av den 10 juni 2022 om fastställande av tekniska genomförandestandarder för tillämpningen av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 vad gäller standarder, format, frekvens samt metoder och arrangemang för rapportering (se sidan 68 i detta nummer av EUT).

h) Att en derivatrapport inte innefattar åtgärdstypen ”Positionskomponent” i fråga om ett derivat som tidigare har rapporterats.

i) Att en derivatrapport inte syftar till att ändra uppgifterna i fälten ”Motpart 1” eller ”Motpart 2” för ett tidigare rapporterat derivat.

j) Att en derivatrapport inte avser att ändra ett befintligt derivat genom att ange ett datum för ikraftträdande som infaller efter den rapporterade förfallodagen för ett derivat.

k) Att ett derivat som rapporteras med åtgärdstypen ”Förnya” avser en tidigare inlämnad derivatrapport med åtgärdstypen ”Fel” eller ”Avsluta” eller ett derivat som har förfallit.

l) Derivatrapportens korrekthet och fullständighet.

2. Ett transaktionsregister ska avvisa en derivatrapport som inte uppfyller något av kraven i punkt 1 och hänföra den till någon av de avvisningskategorier som anges i tabell 1 i bilagan.

3. Inom 60 minuter efter mottagandet av en derivatrapport ska ett transaktionsregister lämna detaljerad information om resultaten av den uppgiftskontroll som avses i punkt 1 till de rapportinlämnande enheterna. Transaktionsregistret ska tillhandahålla dessa resultat i ett xml-format och med hjälp av en mall i enlighet med ISO 20022-metoden. I resultaten ska anges skälen till att en derivatrapport avvisas i enlighet med tabell 1 i bilagan.

Artikel 2

Förfarande för uppdatering av identifieringskoder för juridiska personer (LEI-koder)

1. Ett transaktionsregister till vilket en begäran enligt artikel 8 i genomförandeförordning (EU) 2022/1860 riktas ska identifiera de utestående derivat som avses i artikel 2.2 i genomförandeförordning (EU) 2022/1860 vid tidpunkten för företagsomstruktureringshändelsen, om enheten rapporteras med den identifieringskod som användes före företagsomstruktureringshändelsen i fältet ”Motpart 1” eller ”Motpart 2”, enligt vad som angavs i den relevanta begäran. Den ska ersätta den gamla identifieringskoden med den nya identifieringskoden för juridiska personer (LEI) i rapporterna om samtliga dessa derivat vid tidpunkten för den händelse som avses i artikel 8 i genomförandeförordning (EU) 2022/1860 som hänför sig till den motparten. Ett transaktionsregister ska genomföra förfarandet för uppdatering av identifieringskoden senast på dagen för omstruktureringen eller inom 30 kalenderdagar efter mottagandet av begäran om rapporteringen skedde mindre än 30 kalenderdagar före dagen för företagsomstruktureringshändelsen.

2. Ett transaktionsregister ska identifiera de relevanta derivat som avses i artikel 2.2 i genomförandeförordning (EU) 2022/1860 vid tidpunkten för företagsomstruktureringshändelsen, om enheten identifieras med den gamla identifieringskoden i något av fälten, och ersätta den identifieringskoden med den nya LEI-koden. Om en företagsomstruktureringshändelse avser en uppdatering av LEI-koden för andra fält än ”Motpart 1” eller ”Motpart 2”, ska transaktionsregistret utföra en sådan uppdatering av de relevanta derivaten först efter en bekräftelse i god tid från motpart 1 eller den enhet som ansvarar för rapporteringen.

3. Ett transaktionsregister ska utföra följande uppgifter:

a) Efter mottagandet av den relevanta bekräftelsen enligt punkt 2, genomföra uppdateringen av LEI-koden från och med den dag som avses i punkt 1.

b) Lämna följande information så snart som möjligt, och senast fem arbetsdagar efter mottagandet av den fullständiga anmälan, till alla övriga transaktionsregister och till de rapporterande motparterna, de rapportinlämnande enheterna, de enheter som ansvarar för rapportering och som är involverade i de derivatkontrakt som berörs av uppdateringen av LEI-koden samt till de tredje parter som har beviljats tillgång till information enligt artikel 78.7 i förordning (EU) nr 648/2012, beroende på vad som är tillämpligt:

   i) Den eller de gamla identifieringskoderna.

   ii) Den nya identifieringskoden.

   iii) Det datum från och med vilket uppdateringen ska göras.

   iv) När det gäller företagshändelser som påverkar en underkategori av de derivat som är utestående vid tidpunkten för händelsen, en förteckning över de unika transaktionskoderna (UTI-koderna) för de derivat som berörs av uppdateringen av LEI-koden.

c) Senast den arbetsdag som föregår den dag då uppdateringen tillämpas meddela de enheter som förtecknas i artikel 81.3 i förordning (EU) nr 648/2012 och som har tillgång till uppgifter om de derivat som har uppdaterats, genom en särskild fil i maskinläsbart format,

i) Den eller de gamla identifieringskoderna.

ii) Den nya identifieringskoden.

iii) Det datum från och med vilket uppdateringen ska göras.

iv) när det gäller företagshändelser som påverkar en underkategori av de derivat som är utestående vid tidpunkten för händelsen, en förteckning över UTI-koderna för de derivat som berörs av uppdateringen av LEI-koden.

d) Registrera uppdateringen av LEI-koden i rapporteringsloggen.

4. Ett transaktionsregister ska inte uppdatera de LEI-koder som rapporteras för derivat som skiljer sig från dem som avses i artikel 2.2 i genomförandeförordning (EU) 2022/1860 vid tidpunkten för företagshändelsen.

Artikel 3

Transaktionsregisters avstämning av uppgifter

1. Ett transaktionsregister ska sträva efter att stämma av ett rapporterat derivat genom att följa de steg som anges i punkt 3, under förutsättning att samtliga av följande villkor är uppfyllda:

a) Transaktionsregistret har fullbordat de kontroller som anges i artikel 1.1 och 1.2.

b) Båda motparterna i det rapporterade derivatet har en rapporteringsskyldighet enligt artikel 9 i förordning (EU) nr 648/2012.

c) Transaktionsregistret har inte mottagit någon rapport med åtgärdstypen ”Fel” avseende det rapporterade derivatet, såvida inte denna rapport har följts av en rapport med åtgärdstypen ”Förnya”.

2. Ett transaktionsregister ska ha infört arrangemang för att säkerställa uppgifternas konfidentialitet när det utbyter information med andra transaktionsregister och när det tillhandahåller information till rapporterande motparter, rapportinlämnande enheter, enheter som ansvarar för rapportering samt tredje parter som har beviljats tillgång till information enligt artikel 78.7 i förordning (EU) nr 648/2012 om värdena i alla fält som omfattas av avstämning.

3. Om samtliga villkor i punkt 1 är uppfyllda ska ett transaktionsregister följa följande steg, utgående från det senast rapporterade värdet för vart och ett av fälten i tabell 2 i bilagan på den föregående arbetsdagen:

a) Ett transaktionsregister som mottagit en derivatrapport ska kontrollera om det har mottagit en motsvarande rapport från den andra motparten eller för dennes räkning.

b) Ett transaktionsregister som inte har mottagit en motsvarande derivatrapport enligt led a ska försöka att identifiera det transaktionsregister som har mottagit den motsvarande derivatrapporten genom att till samtliga registrerade transaktionsregister meddela värdena i följande fält för det rapporterade derivatet: ”Unik transaktionsidentifierare”, ”Motpart 1” och ”Motpart 2”.

c) Ett transaktionsregister som fastställer att ett annat transaktionsregister har mottagit en motsvarande derivatrapport enligt led a ska med detta transaktionsregister utbyta närmare uppgifter om det rapporterade derivatet i ett xml-format och med hjälp av en mall som utarbetats i enlighet med ISO 20022-metoden.

d) Ett transaktionsregister ska behandla ett rapporterat derivat som avstämt om de uppgifter om det derivatet som är föremål för avstämning motsvarar uppgifterna om motsvarande derivat enligt led a och i enlighet med de tillämpliga toleransgränser och relevanta tillämpningsdatum som fastställs i tabell 2 i bilagan.

e) Ett transaktionsregister ska därefter tilldela varje rapporterad derivattransaktion värden för avstämningskategorierna i enlighet med vad som anges i tabell 3 i bilagan.

f) Ett transaktionsregister ska slutföra stegen i leden a–e så snabbt som möjligt och får inte utföra något av dessa steg igen efter midnatt koordinerad universell tid (UTC) på en given arbetsdag.

g) Ett transaktionsregister som inte kan stämma av ett rapporterat derivat ska försöka att matcha de närmare uppgifterna om det rapporterade derivatet på följande arbetsdag. Transaktionsregistret ska inte längre försöka stämma av det rapporterade derivatet trettio kalenderdagar efter det att derivatet inte är utestående.

4. Ett transaktionsregister ska vid varje arbetsdags utgång bekräfta det totala antalet matchade derivat med varje transaktionsregister med vilket det har stämt av derivat. Ett transaktionsregister ska ha infört skriftliga förfaranden för att säkerställa att alla diskrepanser som identifieras i denna process åtgärdas.

5. Senast 60 minuter efter det att avstämningsprocessen enligt punkt 3 f har avslutats ska ett transaktionsregister meddela resultaten av den avstämning som det utfört avseende de rapporterade derivaten till de rapportinlämnande enheterna. Transaktionsregistret ska tillhandahålla dessa resultat i ett xml-format och med hjälp av en mall som utarbetats i enlighet med ISO 20022-metoden, inklusive information om de fält som inte har stämts av.

Artikel 4

Svarssystem vid dagens slut

1. För varje arbetsdag ska ett transaktionsregister ge de rapporterande motparterna, de rapportinlämnande enheterna, de enheter som ansvarar för rapporteringen samt de tredjeparter som har beviljats tillgång till information enligt artikel 78.7 i förordning (EU) nr 648/2012, beroende på vad som är tillämpligt, tillgång till följande information om de berörda derivaten i ett xml-format och med hjälp av en mall som utarbetats i enlighet med ISO 20022-metoden:

a) De derivat som rapporterats under dagen.

b) De utestående derivatens senaste handelsstatus.

c) De derivatrapporter som har avvisats under dagen.

d) Avstämningsstatus för alla rapporterade derivat som omfattas av avstämning enligt artikel 3.1.

e) De utestående derivat för vilka ingen värdering har rapporterats eller för vilka den rapporterade värderingen är daterad mer än fjorton kalenderdagar före den dag för vilken rapporten genereras.

f) De utestående derivat för vilka ingen marginalinformation har rapporterats eller för vilka den rapporterade marginalinformationen är daterad mer än fjorton kalenderdagar före den dag för vilken rapporten genereras.

g) De derivat som mottogs den dagen med åtgärdstypen ”Ny”, ”Positionskomponent”, ”Ändring” eller ”Korrigering” och vars teoretiska belopp är onormalt för den klassen av derivat.

2. Ett transaktionsregister ska tillhandahålla denna information senast kl. 06:00 koordinerad universell tid på den arbetsdag som följer på den dag som informationen i punkt 1 avser.

Artikel 5

Ikraftträdande och tillämpning

Denna förordning träder i kraft den tjugonde dagen efter det att den har offentliggjorts i *Europeiska unionens officiella tidning*.

Det ska tillämpas från och med den 29 april 2024.

Denna förordning är till alla delar bindande och direkt tillämplig i alla medlemsstater.

Utfärdad i Bryssel den 10 juni 2022.

På kommissionens vägnar
Ursula VON DER LEYEN
Ordförande

BILAGA

Tabell 1

Skäl till avvisande av en derivatrapport

Avvisningskategorier	Orsak
Databasschema	— derivatet avvisas eftersom databasschemat inte uppfyller villkoren
Rättigheter	— derivatet avvisas eftersom den rapportinlämnande enheten inte får rapportera för den rapporterande motpartens eller den rapporteringsansvariga enhetens räkning
Logik	— derivatet avvisas eftersom åtgärdstypen för derivatet inte är logiskt korrekt.
Företag	— derivatet avvisas eftersom det inte uppfyller villkoren för en eller flera innehållsrelaterade valideringar.

Tabell 2

	Avsnitt	Fält	Tolerans för avstämning	Avstämningens startdatum
1	Parter i derivatet	Rapporteringstillfälle	Ingen uppgift	Ingen uppgift
2	Parter i derivatet	Rapportinlämnande enhets ID	Ingen uppgift	Ingen uppgift
3	Parter i derivatet	Enhet som ansvarar för rapporteringen	Ingen uppgift	Ingen uppgift
4	Parter i derivatet	Motpart 1 (rapporterande motpart)	Samma som i fält 9 i denna tabell	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
5	Parter i derivatet	Typ av motpart 1	Ingen uppgift	Ingen uppgift
6	Parter i derivatet	Bransch för motpart 1	Ingen uppgift	Ingen uppgift
7	Parter i derivatet	Clearingtröskel för motpart 1	Ingen uppgift	Ingen uppgift
8	Parter i derivatet	Typ av identifieringskod för motpart 2	Ingen uppgift	Ingen uppgift
9	Parter i derivatet	Motpart 2	Samma som i fält 4 i denna tabell	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
10	Parter i derivatet	Land för motpart 2	Ingen uppgift	Ingen uppgift
11	Parter i derivatet	Typ av motpart 2	Ingen uppgift	Ingen uppgift

	Avsnitt	Fält	Tolerans för avstämning	Avstämningens startdatum
12	Parter i derivatet	Bransch för motpart 2	Ingen uppgift	Ingen uppgift
13	Parter i derivatet	Clearingtröskel för motpart 2	Ingen uppgift	Ingen uppgift
14	Parter i derivatet	Rapporteringsskyldighet för motpart 2	Ingen uppgift	Ingen uppgift
15	Parter i derivatet	Mäklar-ID	Ingen uppgift	Ingen uppgift
16	Parter i derivatet	Clearingmedlem	Ingen uppgift	Ingen uppgift
17	Parter i derivatet	Riktning	Motsatt	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
18	Parter i derivatet	Riktning för del 1	Motsatt	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
19	Parter i derivatet	Riktning för del 2	Motsatt	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
20	Parter i derivatet	Direkt kopplat till affärsverksamhet eller likviditetsförvaltning	Ingen uppgift	Ingen uppgift
1	Avsnitt 2a – Identifieringskoder och kopplingar	UTI-kod	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
2	Avsnitt 2a – Identifieringskoder och kopplingar	Rapportens spårningsnummer	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
3	Avsnitt 2a – Identifieringskoder och kopplingar	Tidigare UTI-kod (för en-till-en-relationer och en-till-många-relationer mellan transaktioner)	Nej	Två år efter rapporteringsskyldighetens startdatum
4	Avsnitt 2a – Identifieringskoder och kopplingar	UTI-kod för efterföljande position	Nej	Två år efter rapporteringsskyldighetens startdatum
5	Avsnitt 2a – Identifieringskoder och kopplingar	ID för riskreduceringstjänst efter handel	Ingen uppgift	Ingen uppgift
6	Avsnitt 2a – Identifieringskoder och kopplingar	Paketets identifieringskod	Ingen uppgift	Ingen uppgift
7	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	ISIN-kod (International Securities Identification Number)	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
8	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Unik produktbeteckning (UPI-kod)	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten

	Avsnitt	Fält	Tolerans för avstämning	Avstämningens startdatum
9	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Produktklassificering	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
10	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Typ av kontrakt	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
11	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Tillgångsklass	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
12	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Derivat baserade på kryptotillgångar	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
13	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Typ av identifiering av det underliggande	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
14	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Identifiering av det underliggande	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
15	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Indikator för underliggande index	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
16	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Namn på underliggande index	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
17	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Anpassad korgkod	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
18	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Identifieringskod för korgens beståndsdelar	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
19	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Avvecklingsvaluta 1	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
20	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Avvecklingsvaluta 2	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
21	Avsnitt 2c – värdering	Värderingsbelopp	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
22	Avsnitt 2c – värdering	Värderingsvaluta	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
23	Avsnitt 2c – värdering	Tidsangivelse för värdering	Ingen uppgift	Ingen uppgift

	Avsnitt	Fält	Tolerans för avstämning	Avstämningens startdatum
24	Avsnitt 2c – värdering	Värderingsmetod	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
25	Avsnitt 2c – värdering	Delta	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
26	Avsnitt 2d – säkerhet	Indikator för portföljsäkerhet	Ingen uppgift	Ingen uppgift
27	Avsnitt 2d – säkerhet	Kod för portföljsäkerhet	Ingen uppgift	Ingen uppgift
28	Avsnitt 2e – riskreducering/ riskrapportering	Bekräftelsetillfälle	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
29	Avsnitt 2e – riskreducering/ riskrapportering	Bekräftat	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
30	Avsnitt 2f – clearing	Clearingkrav	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
31	Avsnitt 2f – clearing	Clearat	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
32	Avsnitt 2f – clearing	Clearingtillfälle	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
33	Avsnitt 2f – clearing	Central motpart	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
34	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ramavtalstyp	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
35	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Annan ramavtalstyp	Ingen uppgift	Ingen uppgift
36	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ramavtalsversion	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
37	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Inom gruppen	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
38	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Riskreduceringstjänst efter handel	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
39	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Typ av teknik för riskreduceringstjänst efter handel	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten

	Avsnitt	Fält	Tolerans för avstämning	Avstämningens startdatum
40	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Leverantör av riskreduceringstjänst efter handel	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
41	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Handelsplats	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
42	Avsnitt 2c – uppgifter om transaktionen	Genomförandetillfälle	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
43	Avsnitt 2c – uppgifter om transaktionen	Ikraftträdandedatum	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
44	Avsnitt 2c – uppgifter om transaktionen	Sista giltighetsdatum	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
45	Avsnitt 2c – uppgifter om transaktionen	Datum för förtida avslutande	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
46	Avsnitt 2c – uppgifter om transaktionen	Slutlig avtalad avvecklingsdag	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
47	Avsnitt 2c – uppgifter om transaktionen	Typ av leverans	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
48	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Pris	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
49	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Prisvaluta	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
50	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ojusterat ikraftträdandedatum för priset	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
51	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ojusterat slutdatum för priset	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
52	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Pris som gäller mellan det ojusterade ikraftträdandedatumet och slutdatumet	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
53	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Pris för pakettransaktion	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
54	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Valuta för pakettransaktionens pris	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum

	Avsnitt	Fält	Tolerans för avstämning	Avstämningens startdatum
55	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretiskt belopp för del 1	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
56	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretisk valuta 1	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
57	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ikraftträdandedatum för det teoretiska beloppet för del 1	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
58	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Slutdatum för det teoretiska beloppet för del 1	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
59	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretiskt belopp som gäller från och med tillhörande ikraftträdandedatum för del 1	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
60	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Total teoretisk kvantitet för del 1	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
61	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ikraftträdandedatum för den teoretiska kvantiteten för del 1	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
62	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Slutdatum för den teoretiska kvantiteten för del 1	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
63	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretisk kvantitet som gäller på tillhörande ikraftträdandedatum för del 1	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
64	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretiskt belopp för del 2	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
65	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretisk valuta 2	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
66	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ikraftträdandedatum för det teoretiska beloppet för del 2	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
67	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Slutdatum för det teoretiska beloppet för del 2	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
68	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretiskt belopp som gäller på tillhörande ikraftträdandedatum för del 2	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
69	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Total teoretisk kvantitet för del 2	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
70	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ikraftträdandedatum för den teoretiska kvantiteten för del 2	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
71	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Slutdatum för den teoretiska kvantiteten för del 2	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten

	Avsnitt	Fält	Tolerans för avstämning	Avstämningens startdatum
72	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretisk kvantitet som gäller på tillhörande ikraftträdandedatum för del 2	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
73	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Annan betalningstyp	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
74	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Annat betalningsbelopp	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
75	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Annan betalningsvaluta	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
76	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Annat betalningsdatum	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
77	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Annan betalare	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
78	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Annan betalningsmottagare	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
79	Avsnitt 2h – räntor	Fast ränta för del 1 eller kupong	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
80	Avsnitt 2h – räntor	Dagberäkningsmetod för fast ränta eller kupong för del 1	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
81	Avsnitt 2h – räntor	Betalningsfrekvensperiod för fast ränta eller kupong för del 1	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
82	Avsnitt 2h – räntor	Multiplikator för betalningsfrekvensperiod för fast ränta eller kupong för del 1	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
83	Avsnitt 2h – räntor	Identifieringskod för rörlig ränta för del 1	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
84	Avsnitt 2h – räntor	Indikator för rörlig ränta för del 1	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
85	Avsnitt 2h – räntor	Namn på rörlig ränta för del 1	Ingen uppgift	Ingen uppgift
86	Avsnitt 2h – räntor	Dagberäkningsmetod för rörlig ränta för del 1	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten

	Avsnitt	Fält	Tolerans för avstämning	Avstämningens startdatum
87	Avsnitt 2h – räntor	Betalningsfrekvensperiod för rörlig ränta för del 1	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
88	Avsnitt 2h – räntor	Multiplikator för betalningsfrekvensperiod för rörlig ränta för del 1	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
89	Avsnitt 2h – räntor	Referensperiod för rörlig ränta för del 1 – periodangivelse	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
90	Avsnitt 2h – räntor	Referensperiod för rörlig ränta för del 1 – multiplikator	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
91	Avsnitt 2h – räntor	Justeringsfrekvensperiod för rörlig ränta för del 1	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
92	Avsnitt 2h – räntor	Multiplikator för justeringsfrekvens för rörlig ränta för del 1	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
93	Avsnitt 2h – räntor	Spread för del 1	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
94	Avsnitt 2h – räntor	Spreadvaluta för del 1	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
95	Avsnitt 2h – räntor	Fast ränta för del 2	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
96	Avsnitt 2h – räntor	Dagberäkningsmetod för fast ränta för del 2	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
97	Avsnitt 2h – räntor	Betalningsfrekvensperiod för fast ränta för del 2	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
98	Avsnitt 2h – räntor	Multiplikator för betalningsfrekvensperiod för fast ränta för del 2	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
99	Avsnitt 2h – räntor	Identifieringskod för rörlig ränta för del 2	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
100	Avsnitt 2h – räntor	Indikator för rörlig ränta för del 2	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
101	Avsnitt 2h – räntor	Namn på rörlig ränta för del 2	Ingen uppgift	Ingen uppgift
102	Avsnitt 2h – räntor	Dagberäkningsmetod för rörlig ränta för del 2	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
103	Avsnitt 2h – räntor	Betalningsfrekvensperiod för rörlig ränta för del 2	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten

	Avsnitt	Fält	Tolerans för avstämning	Avstämningens startdatum
104	Avsnitt 2h – räntor	Multiplikator för betalningsfrekvensperiod för rörlig ränta för del 2	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
105	Avsnitt 2h – räntor	Referensperiod för rörlig ränta för del 2 – periodangivelse	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
106	Avsnitt 2h – räntor	Referensperiod för rörlig ränta för del 2 – multiplikator	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
107	Avsnitt 2h – räntor	Justeringsfrekvensperiod för rörlig ränta för del 2	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
108	Avsnitt 2h – räntor	Multiplikator för justeringsfrekvens för rörlig ränta för del 2	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
109	Avsnitt 2h – räntor	Spread för del 2	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
110	Avsnitt 2h – räntor	Spreadvaluta för del 2	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
111	Avsnitt 2h – räntor	Spread för pakettransaktion	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
112	Avsnitt 2h – räntor	Spreadvaluta för pakettransaktion	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
113	Avsnitt 2i – utländsk valuta	Växelkurs 1	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
114	Avsnitt 2i – utländsk valuta	Terminsväxelkurs	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
115	Avsnitt 2i – utländsk valuta	Valutakombination för växelkurs	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
116	Avsnitt 2j – råvaror och utsläppsrätter (allmänt)	Basprodukt	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
117	Avsnitt 2j – råvaror och utsläppsrätter (allmänt)	Underprodukt	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum

	Avsnitt	Fält	Tolerans för avstämning	Avstämningens startdatum
118	Avsnitt 2j – råvaror och utsläppsrätter (allmänt)	Ytterligare underprodukt	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
119	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Leveransställe eller -zon	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
120	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Förbindelsepunkt	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
121	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Lasttyp	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
122	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Starttid för leveransintervall	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
123	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Sluttid för leveransintervall	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
124	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Leveransens startdatum	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
125	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Leveransens slutdatum	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
126	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Löptid	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
127	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Veckodagar	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
128	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Leveranskapacitet	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum

	Avsnitt	Fält	Tolerans för avstämning	Avstämningens startdatum
129	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Kvantitetsmått	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
130	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Pris/tidsintervall och kvantitet	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
131	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Valuta för pris/tidsintervall och kvantitet	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
132	Avsnitt 2l – optioner	Optionsslag	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
133	Avsnitt 2l – optioner	Optionstyp	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
134	Avsnitt 2l – optioner	Lösenpris	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
135	Avsnitt 2l – optioner	Ikraftträdandedatum för lösenpriset	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
136	Avsnitt 2l – optioner	Slutdatum för lösenpriset	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
137	Avsnitt 2l – optioner	Lösenpris som gäller på det tillhörande ikraftträdandedatumet	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
138	Avsnitt 2l – optioner	Lösenprisets valuta/valutapar	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
139	Avsnitt 2l – optioner	Belopp för optionspremium	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
140	Avsnitt 2l – optioner	Valuta för optionspremium	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
141	Avsnitt 2l – optioner	Betalningsdatum för optionspremium	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum

	Avsnitt	Fält	Tolerans för avstämning	Avstämningens startdatum
142	Avsnitt 2i – optioner	Förfallodag för det underliggande	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
143	Sektion 2m – kreditderivat	Prioritet	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
144	Sektion 2m – kreditderivat	Referensenhet	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
145	Sektion 2m – kreditderivat	Serie	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
146	Sektion 2m – kreditderivat	Version	Nej	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
147	Sektion 2m – kreditderivat	Indexfaktor	Ja	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
148	Sektion 2m – kreditderivat	Tranch	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten
149	Sektion 2m – kreditderivat	Attachment point för index för kreditswappar (CDS)	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
150	Sektion 2m – kreditderivat	Detachment point för index för kreditderivatswappar	Ja	Två år från rapporteringsskyldighetens startdatum
151	Avsnitt 2n – ändring av derivatet	Åtgärdstyp	Ingen uppgift	Ingen uppgift
152	Avsnitt 2n – ändring av derivatet	Händelsetyp	Ingen uppgift	Ingen uppgift
153	Avsnitt 2n – ändring av derivatet	Datum för händelsen	Ingen uppgift	Ingen uppgift
154	Avsnitt 2n – ändring av derivatet	Nivå	Nej	Startdatum för rapporteringsskyldigheten

Tabell 3

Avstämningskategorier	Tillåtna värden
Rapporteringsskyldighet för båda motparter	Ja/Nej
Rapporteringstyp	Enpartsrapportering/tvåpartsrapportering
Matchning	Matchat/Ej matchat
Avstämning	Avstämt/Ej avstämt
Värderingsavstämning	Avstämt/Ej avstämt
Förnyat	Ja/Nej
Ytterligare ändringar	Ja/Nej